



Información del 26-10-2017 al 27-10-2017

OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO Y MONETARIO DIARIO

TIPO DE CAMBIO			UFV
Fecha	Compra	Venta	
27/10/2017	6,86	6,96	2,22514

I.- OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO**A. OFERTA DE VALORES EN MESA DE DINERO**

i. Vigente del 27/10/2017 al 31/10/2017

Valor	Moneda	Plazo en Días	Periodo de Protección (a)	Cantidad de Valores (b)	TR % (c)
LR-MN	MN	182	91	50.000	0,4504
LR-MN	MN	273	91	50.000	0,5052
LR-MN	MN	364	91	50.000	0,6300
BT 3,20%	MN	3.640	-	15.000	1,1998
BT 3,60%	MN	5.460	-	20.000	1,8400
BT 3,80%	MN	7.280	-	50.000	2,1688
BT 4,00%	MN	10.920	-	60.000	2,2801
BT 4,10%	MN	18.200	-	40.000	2,8011
BT 4,30%	MN	36.400	-	15.000	3,5870

a) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado. El periodo de protección se contabiliza a partir de la fecha de emisión de los valores rescatables. Cuando la colocación de estos valores se realice en días posteriores a la fecha de emisión, a través de Mesa de Dinero, el periodo de protección se ajustará según el plazo restante que corresponda.

b) Cada título tiene un valor nominal de 1.000 unidades en moneda origen.

c) Tasa de rendimiento efectiva.

B. OPERACIONES DE REPORTO

i. Operaciones de Reporto vigentes

No existen operaciones Vigentes.

ii. Oferta diaria máxima de Reportos

(*) Vigente del 26/10/2017 al 01/11/2017

Moneda	Saldo Diario Disponible desde 23-10-14	Tasa	TEA (e)	Tasa	TEA (e)	Plazo (En días) Máximo	Tasa de Valoración (g)
		Subasta (d)	Subasta	Mesa (f)	Mesa		
MN	600.000.000	2,50%	2,53%	3,00%	3,04%	15	7,50%
ME	5.000.000	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15	12,50%

d) Tasa vigente del 26/10/2017 al 01/11/2017.

e) TEA referencial calculada para un plazo de 15 días.

f) 50 puntos básicos sobre la tasa premio más alta adjudicada en subasta.

g) Tasa de valoración utilizada para determinar el valor de día de una operación de reporto con colaterales en MN y ME. Para colaterales en UFV la tasa es 5,50%

iii. Saldo vigente máximo para Reportos

(*) Vigente del 26/10/2017 al 01/11/2017

Moneda	Saldo Disponible Semanal	Tasa	TEA (e)	Tasa	TEA (e)	Plazo (En días) Máximo
		Subasta (d)	Subasta	Mesa (f)	Mesa	
MN	3.000.000.000,00	2,50%	2,53%	3,00%	3,04%	15
ME	25.000.000,00	4,00%	4,08%	4,50%	4,60%	15

iv. Créditos con garantía del Fondo RAL (h)

Tramos	MN	TEA (i)	ME	TEA (i)
1er	4,00%	4,08%	5,50%	5,65%
2do	4,50%	4,60%	6,00%	6,18%

h) Estas operaciones se realizan directamente con la Gerencia de Entidades Financieras del BCB.

i) TEA calculada para un plazo de 7 días.

C. DEPÓSITO ESPECIAL DE REGULACIÓN MONETARIA

i. Operaciones de DERM vigentes

No existe oferta

D. OFERTA DE VALORES EN SUBASTA

i. Subasta Electrónica de Valores Públicos de la semana 44/2017

miércoles 01/11/2017 Apertura: Hrs:9:00 am.

Valor	Emisor	Cierre	Periodo de protección (j)	Moneda	Plazo (En días)	Modalidad	Cantidad
LR-MN	BCB	09:10	-	MN	91	Competitiva	100.000
LR-MN	BCB	09:20	91	MN	182	Competitiva	100.000
LR-MN	BCB	09:30	91	MN	273	Competitiva	200.000
LR-MN	BCB	09:40	91	MN	364	Competitiva	100.000
BT-MN 3,20%	TGN	09:10	-	MN	3.640	Competitiva	15.000
BT-MN 3,60%	TGN	09:20	-	MN	5.460	Competitiva	15.000
BT-MN 3,80%	TGN	09:30	-	MN	7.280	Competitiva	25.000
BT-MN 4,00%	TGN	09:40	-	MN	10.920	Competitiva	30.000
BT-MN 4,10%	TGN	09:50	-	MN	18.200	Competitiva	10.000
BT-MN 4,30%	TGN	10:00	-	MN	36.400	Competitiva	5.000

(j) En días, corresponde a los títulos con opción de rescate anticipado.

II MERCADO MONETARIO

OPERACIONES INTERBANCARIAS DEL SISTEMA BANCARIO (*) (en miles)

Fecha al:	i) Moneda Nacional			Plazo Prom.	Monto	ii) Moneda Extranjera				
	Min.	Max.	Prom. (**)			Min.	Max.	Prom. (**)	Plazo Prom.	Monto
20-oct	2,40%	2,40%	2,40%	7	46.800	2,70%	2,70%	2,70%	14	4.000
23-oct	2,40%	2,40%	2,40%	9	20.000	2,70%	2,70%	2,70%	14	4.000
24-oct	2,40%	2,40%	2,40%	7	60.000	2,40%	2,40%	2,40%	14	2.000
25-oct	2,40%	2,40%	2,40%	8	100.000	-	-	-	-	-
26-oct	2,38%	2,40%	2,39%	12	100.000	3,00%	3,00%	3,00%	28	7.000

Operaciones interbancarias realizadas por sondeo. Datos Preliminares.

(*) Incluye operaciones de Entidades Financieras de Vivienda.

(**) Promedio Ponderado por monto y plazo.

III. OPERACIONES DE REPORTE REALIZADAS EN EL RUEDO DE LA BOLSA BOLIVIANA DE VALORES - 26/10/2017

Instrumentos	Monto negociado (en dólares americanos)	Moneda	Valores	Tasas de rendimiento según rango de plazo en días					
				1 - 7	8 - 15	16 - 22	23 - 30	31 - 37	38 - 45
Bonos Bancarios Bursátiles	971.625,32	BS	BEC	2,40%					
Bonos del Banco Central de Bolivia			BGA						2,29%
Bonos de Largo Plazo	883.582,85		BIS	3,00%			2,60%		
Bonos del Tesoro			BME	2,50%	2,47%				2,50%
Cupones de Bonos			BNB	2,30%					
Depósitos a Plazo Fijo	32.018.401,83		BSO	2,30%				2,20%	2,30%
Letras del Banco Central de Bolivia			BTB			2,30%			2,28%
Letras BCB Prepagables			BUN						2,00%
Pagarés Bursátiles			CJN						1,90%
Valores de Contenido Crediticio	23.874,05		FCO						1,90%
Total	33.897.484,05		FEC						2,33%
			FIE				2,27%	2,00%	2,30%
			FPR	2,43%					
		BEC						2,30%	
		BNB						2,30%	
		FIE			2,10%			2,30%	
		DIN			2,30%				
		FEF						2,30%	
		GYE					2,30%	2,20%	
		IOL			2,30%			2,30%	
		VCR						2,30%	
		BUN						0,35%	
		BNB						0,35%	
		FCO						0,35%	
		IOL						0,30%	
		POL						0,30%	

Fuente: BBV

IV MERCADO INTERNACIONAL - PRINCIPALES INDICADORES

Plazo semanas	A. TASAS DE LETRAS DEL TESORO				
	EEUU 26-oct-2017	Arg \$ (*) 25-oct-2017	Chile \$ 25-oct-2017	Méx MN(m) 26-oct-2017	Libor (\$us) 26-oct-2017
4	0,96 ↓	26,50	2,47	7,04	1,242 ↑
13	1,08	27,00	2,50	7,13	1,378 ↑
26	1,25 ↑	27,35	-	7,20	1,564 ↑
36	-	27,35	-	-	-
52	-	-	-	7,30	1,843 ↓
Prime Rate		4,25			
Fed Funds		1,16			

(m) Mercado Secundario

(*) En Argentina, las TR corresponden a 4,13, 30 y 39 semanas.

B. TIPOS DE CAMBIO			
TIPO DE CAMBIO (c) al 26-oct-17			
Argentina	17,658 ↑	Japón	114,050 ↑
Reino Unido	0,760 ↑	México	19,206 ↑
Brasil	3,297 ↑	Perú	3,241 ↑
Chile	632,980 ↑	Unión Europea	0,8584 ↑

(c) Respecto al dólar

Atentamente,

LA SUBGERENCIA DE OPERACIONES DE MERCADO ABIERTO DEL BANCO CENTRAL DE BOLIVIA